


ХАРКІВСЬКИЙ НАЦІОНАЛЬНИЙ УНІВЕРСИТЕТ МІСЬКОГО ГОСПОДАРСТВА

імені О.М. БЕКЕТОВА

Кафедра економіки підприємств міського господарства

“ЗАТВЕРДЖУЮ”

Директор ЦПО і ЗН


(Ачкасов А.Є.)
“ 21 ” 10 2014 року
М.П.

РОБОЧА ПРОГРАМА НАВЧАЛЬНОЇ ДИСЦИПЛІНИ

**3.7.5 ОБГРУНТУВАННЯ ГОСПОДАРСЬКИХ РІШЕНЬ І
ОЦІНЮВАННЯ РИЗИКІВ**

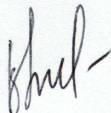
галузь знань 0305 Економіка і підприємництво

напрямок підготовки 6.030504 Економіка підприємства

центр післядипломної освіти і заочного навчання

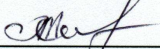
2014 – 2015 НАВЧАЛЬНИЙ РІК

Робоча програма «Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків»
для студентів за напрямом підготовки 6.030504 «Економіка підприємства»

Розробники: к.е.н., доцент, доцент кафедри ЕПМГ Петрова В.Ф. 

Робочу програму схвалено на засіданні кафедри Економіки підприємств міського
господарства

Протокол від “29” серпня 2014 року №1

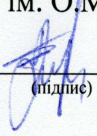
Завідувач кафедри  (Ачкасов А.Є.)

Робочу програму схвалено на засіданні випускової кафедри Економіки
підприємств міського господарства

Протокол від “29” серпня 2014 року № 1

Завідувач випускової кафедри  (Ачкасов А.Є.)

Програма відповідає формі Програми навчальної дисципліни, що затверджена
Наказом по ХНУМГ ім. О.М. Бекетова від 24 лютого 2014 р. № 46-01

Методист НМВ  (підпис) (Чайковська ВВ “21” жовтня 2014 р.)
(ПІБ)

© ХНУМГ ім. О.М. Бекетова , 2014 рік

© Петрова В. Ф., 2014 рік

1. Опис навчальної дисципліни

Найменування показників ↓↓↓	Галузь знань, напрям підготовки, освітньо-кваліфікаційний рівень	Характеристика навчальної дисципліни	
		денна форма навчання	заочна форма навчання
Кількість кредитів <u>5</u>	Нормативна	Рік (роки) підготовки	
		-	4-й
		Семестр(и)	
		-	8-й
Загальна кількість годин – 180	Галузь знань 0305 – Економіка і підприємництво Напрямок підготовки 6.030504 – Економіка підприємства	Лекції:	
- год.		10 год.	
Модулів – 1		Практичні, семінарські:	
- год.		10 год.	
Змістових модулів (ЗМ) – 2		Лабораторні:	
- год.		- год.	
Тижневих годин для денної форми навчання: аудиторних – - самостійної роботи студента – -	Освітньо-кваліфікаційний рівень: бакалавр	Самостійна робота:	
Індивідуальне (науково-дослідне) завдання (ІЗ): Розрахунково-графічне завдання- «Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків»		год.	160 год.
		Індивідуальні завдання:	
		- год.	18 год.
		Вид контролю:	
-	екзамен		

Питома вага кількості аудиторних годин в загальному обсязі дисципліни становить:

для заочної форми навчання – 11 %

2. Мета та завдання навчальної дисципліни

Мета – формування знань і навичок стосовно обґрунтування господарських рішень з різним ступенем невизначеності та ризику.

Завдання вивчення дисципліни – засвоєння основних принципів обґрунтування різних видів господарських рішень, методичних підходів щодо аналізу ризику та управління ним;

- оволодіння навичками самостійно здійснювати аналіз, ідентифікацію та оцінювання ризику, використовуючи комп'ютерну техніку та програмно-математичні комплекси.

У результаті вивчення навчальної дисципліни студент повинен

знати:

- основні поняття й категорії обґрунтування господарських рішень та оцінки підприємницьких ризиків;
- сучасні методи й моделі розроблення, обґрунтування та прийняття господарських рішень;
- основні принципи й підходи до обґрунтування господарських рішень в умовах невизначеності та ризику;
- природу виникнення ризиків, їх різновиди, вплив на якість господарських рішень;
- методичні основи кількісного та якісного аналізу підприємницьких ризиків;
- теоретичні аспекти ризик-менеджменту та напрями регулювання підприємницьких ризиків.

вміти:

- визначати оптимальні форми подання та реалізації господарських рішень;
- розробляти й обґрунтовувати господарські рішення на основі комплексу методів і моделей, системи показників економічного обґрунтування рішень;
- обґрунтовувати вибір оптимального господарського рішення в умовах невизначеності та ризику;
- аналізувати ефективність інвестиційних і фінансових рішень;
- здійснювати ідентифікацію, аналіз та оцінювання ризику, використовуючи комп'ютерну техніку та програмно-математичні комплекси;
- визначати напрями та методи регулювання господарських ризиків на підприємстві.

мати компетентності:

- з отримання певного досвіду сутнісного аналізу інвестиційних і фінансових рішень;
- в використуванні наявних професійних знань для вирішення завдань, зокрема з обґрунтування різних видів господарських рішень ;
- в прийнятті рішень в обґрунтуванні вибору оптимального господарського рішення в умовах невизначеності та ризику;

- з формування комунікативного досвіду із застосування професійного категорійного апарату в визначенні напрямів та методів регулювання господарських ризиків на підприємстві.

3. Програма навчальної дисципліни

МОДУЛЬ 1. ОБГРУНТУВАННЯ ГОСПОДАРСЬКИХ РІШЕНЬ ТА ОЦІНЮВАННЯ РИЗИКІВ

Змістовий модуль 1 Господарські рішення в різних сферах підприємницької діяльності

Тема 1. Сутнісна характеристика господарських рішень

Поняття господарських рішень та їхні ознаки. Сутність господарських рішень. Класифікація господарських рішень. Вимоги до господарських рішень та умови їх досягнення.

Способи формалізації та реалізації господарських рішень. Визначення оптимальних форм подання та реалізації господарських рішень.

Якість та ефективність господарських рішень. Основні параметри та показники якісного рішення. Умови забезпечення якості господарського рішення. Види ефективності господарських рішень. Умови та перешкоди прийняття ефективного рішення. Принципи оцінювання ефективності господарських рішень.

Тема 2. Технологія прийняття рішень господарської діяльності

Процес, етапи, процедури, стилі та основні способи прийняття рішень та його елементи.

Характер прийняття господарських рішень. Основні чинники, що впливають на прийняття рішення. Характеристика видів контролю.

Закони й закономірності, що впливають на прийняття рішень. Загальні закони управління людиною. Закон інерційності людських систем. Закони зв'язку з зовнішнім середовищем. Соціально-психологічні та біопсихічні закони.

Тема 3. Методичні основи підготовки господарських рішень

Методи розроблення господарських рішень. Аналітичні, статистичні та математичні методи. Експертні методи та межі їх застосування. Види експертних оцінок. Сутність евристичного програмування та його різновиди. Евристичні методи групової та індивідуальної роботи. Ділові й організаційно-діяльнісні ігри. Метод сценаріїв. Сутність і види методу «дерево цілей».

Обґрунтування господарських рішень. Методичні основи обґрунтування господарських рішень. Підходи до обґрунтування й вибору господарських рішень. Комплексний підхід до обґрунтування господарських рішень.

Тема 4. Обґрунтування господарських рішень та оцінювання їх ефективності

Роль економіко-математичного моделювання у підготовці рішень.

Критерії оцінки ефективності рішень. Прийняття рішень в умовах багатокритеріальності.

Методи головного показника, зведеного показника, послідовних узгоджень.

Тема 5. Прогнозування та аналіз господарських рішень

Основні завдання прогнозування. Головні принципи прогнозування господарських рішень.

Сутність та принципи аналізу господарських рішень.

Методи аналізу господарських рішень та їхній інструментарій. Сфери застосування методів та інструментів прийняття господарських рішень.

Змістовий модуль 2. Ризик і невизначеність під час обґрунтування господарських рішень

Тема 6. Невизначеність як першопричина ризику підприємницької діяльності

Природа невизначеності. Види невизначеності.

Міри та шкали ступіня невизначеності.

Невизначеність як першоджерело ризику. Чутливість. Сталість.

Тема 7. Критерії прийняття рішень в умовах невизначеності

Критерії прийняття рішень в умовах відсутності кількісних мір невизначеності: обережний критерій (критерій Вальда), оптимістичний критерій, компромісні критерії, критерії мінімуму жалю.

Критерії прийняття рішень в умовах наявності кількісної міри невизначеності.

Тема 8. Теорія корисності та її застосування у процесі прийняття рішень

Основи теорії корисності. Суб'єктивний характер корисності. Оцінювання корисності.

Функція корисності Неймана-Моргенштерна.

Оцінювання схильності / несхильності до ризику. Детермінований еквівалент корисності.

Тема 9. Підприємницькі ризики та їх вплив на прийняття господарських рішень

Ризик у діяльності суб'єкта господарювання. Сутнісна характеристика ризику. Ризик як економічна категорія. Ризик і невизначеність. Основні риси, чинники та функції ризику в підприємницькій діяльності.

Класифікація підприємницьких ризиків..

Обґрунтування господарських рішень в умовах ризику. Характеристика критеріїв прийняття рішень за умов ризику.

Тема 10. Критерії прийняття господарських рішень за умов ризику

Врахування ризику під час формування критеріїв прийняття рішень.

Критерії, що мінімізують ризик. Застосування оцінок схильності / несхильності до ризику.

3.Багатокритеріальність задач прийняття рішень за умов ризику.

Тема 11. Прийняття рішень у конфліктних ситуаціях

Види конфліктів. Цілі учасників конфліктних ситуацій.

Моделі конфліктних ситуацій. Застосування елементів теорії ігор. Гарантований результат гри. Модель торгів.

Тема 12. Обґрунтування інвестиційних і фінансових рішень за умов ризику

Інвестиційні рішення та критерій ефективності їх прийняття. Критерії обґрунтування рішень під час прийняття (вибору) інвестиційного проекту. Врахування ризику при обґрунтуванні ставки дисконтування. Коефіцієнт систематичного ризику. Опціональний критерій прийняття рішень. Систематичний ризик і очікувана дохідність компанії.

Сутність фінансових рішень. Портфелі Г. Марковіца і Р. Гобіна. Теорія оптимального портфеля. Формування оптимального портфеля з обмеженої кількості цінних паперів.

Тема 13. Якісне оцінювання підприємницьких ризиків

Загальна характеристика методів. Зони та рівні ризику.

Метод експертних оцінок.

Тема 14. Кількісне оцінювання підприємницьких ризиків

Кількісні методи аналізу та оцінювання ризику. Ймовірнісний підхід до оцінювання ризиків.

Дерево ймовірностей. Детермінований еквівалент цільової функції.

Тема 15. Основи ризик-менеджменту

Необхідність управління ризиками господарської діяльності. Сутність ризик-менеджменту. Структурна схема ризик-менеджменту. Процес управління ризиками господарської діяльності на підприємстві та характеристика його етапів.

Основні напрями й методи впливу на ступінь ризику господарювання.

Тема 16. Напрями і методи регулювання та зниження ступеня ризику.

Відмовлення від ризику, зниження ризику, розподіл ризику, об'єднання ризиків, диверсифікація ризиків, хеджування ризиків.

Структура навчальної дисципліни

Назви змістових модулів і тем	Кількість годин									
	денна форма					заочна форма				
	усього	у тому числі				усього	у тому числі			
		лек	лаб	пр/сем	срс		лек	лаб	пр/сем	срс
1	2	3	4	5	6	7	8	9	10	11
МОДУЛЬ 1. ОБґРУНТУВАННЯ ГОСПОДАРСЬКИХ РІШЕНЬ ТА ОЦІНЮВАННЯ РИЗИКІВ (семестр 8)										
Змістовий модуль 1. Господарські рішення в різних сферах підприємницької діяльності										
Тема 1.						7	1	-	-	6
Тема 2.						7	1	-	-	6
Тема 3.						12	-	-	2	10
Тема 4.						11	1	-	-	10
Тема 5.						10	-	-	-	10
Разом за ЗМ 1						47	3		2	42

Змістовий модуль 2. Ризик і невизначеність під час обґрунтування господарських рішень										
Тема 6.						9	1	-	-	8
Тема 7.						9	1	-	-	8
Тема 8.						13	-	-	1	12
Тема 9.						10	1	-	1	8
Тема 10.						10	-	-	-	10
Тема 11.						11	-	-	-	11
Тема 12.						11	1	-	2	8
Тема 13.						11	1	-	-	10
Тема 14.						13	1	-	2	10
Тема 15.						6	1	-	-	5
Тема 16.						12	-	-	2	10
Разом на 3М2						115	7		8	100
Розрахунково-графічне завдання-«Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків»										
Розрахунково-графічне завдання		-	-	-		18	-	-	-	18
Усього годин						162	10		10	142
Разом						180	10		10	160

5. Теми практичних занять

№ з/п	Назва теми	Кількість годин	
		денна	заочна
1	Тема 3. Методичні основи підготовки господарських рішень	-	2
2	Тема 8. Теорія корисності та її застосування у процесі прийняття рішень	-	1
3.	Тема 9. Підприємницькі ризики та їх вплив на прийняття господарських рішень	-	1
4	Тема 12 Обґрунтування інвестиційних і фінансових рішень за умов ризику	-	2
5	Тема 14. Кількісне оцінювання підприємницьких ризиків	-	2
6	Тема 16. Напрями і методи регулювання та зниження ступеня ризику.	-	2
Разом		-	10

7.Теми лабораторних занять

Не передбачено

8. Самостійна робота

№ з/п	Назва теми	Кількість годин	
		денна	заочна
1	Тема 1. Сутнісна характеристика господарських рішень	-	6
2	Тема 2. Технологія прийняття рішень господарської діяльності	-	6
3	Тема 3. Методичні основи підготовки господарських рішень	-	10
4	Тема 4. Обґрунтування господарських рішень та оцінювання їх ефективності	-	10
5	Тема 5. Прогнозування та аналіз господарських рішень	-	10
6	Тема 6. Невизначеність як першопричина ризику підприємницької діяльності	-	8
7	Тема 7. Критерії прийняття рішень в умовах невизначеності	-	8
8	Тема 8. Теорія корисності та її застосування у процесі прийняття рішень	-	12
9	Тема 9. Підприємницькі ризики та їх вплив на прийняття господарських рішень	-	8
10	Тема 10. Критерії прийняття господарських рішень за умов ризику	-	10
11	Тема 11. Прийняття рішень у конфліктних ситуаціях	-	11
12	Тема 12. Обґрунтування інвестиційних і фінансових рішень за умов ризику	-	8
13	Тема 13. Якісне оцінювання підприємницьких ризиків	-	10
14	Тема 14. Кількісне оцінювання підприємницьких ризиків	-	10
15	Тема 15. Основи ризик-менеджменту	-	5
16	Тема 16. Напрями і методи регулювання та зниження ступеня ризику.	-	10
	Розрахунково-графічне завдання	-	18
	Разом	-	160

9. Індивідуальні завдання

Розрахунково-графічне завдання «Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків»

Виконання розрахунково-графічного завдання є одним із етапів вивчення курсу «Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків». Мета розрахунково-графічного завдання – закріплення та поглиблення теоретичних знань, здобутих при вивченні дисципліни, формування практичних навичок у прийнятті господарських рішень.

Розрахунково-графічне завдання складається з наступних елементів: зміст (план роботи), вступ, розділи основної частини, висновки, список використаних джерел. Обсяг контрольної роботи – 15-20 аркушів друкованого тексту.

10. Методи навчання

У процесі навчання студенти отримують необхідні знання під час проведення аудиторних занять: лекційних та практичних. При цьому використовуються наступні методи навчання: словесні, наочні, практичні, репродуктивні (пояснювально-ілюстративні). Виконання вправ. Конспектування лекцій. Самостійна робота.

11. Методи контролю

Розрахунково-графічне завдання. Тестування. Практична перевірка умінь і навичок. Виконання вправ. Письмовий контроль (контрольна робота). Екзамен, який проводиться письмово за екзаменаційними білетами.

12. Розподіл балів, які отримують студенти

Поточна атестація та самостійна робота					Підсумковий контроль (екзамен)	Сума
	ЗМ1	ЗМ 2		ІЗ		
	15%		35%	20%	30%	100%
70%						

Шкала оцінювання: національна та ЄКТС

Сума балів за всі види навчальної діяльності	Оцінка за національною шкалою		Оцінка за шкалою ЄКТС
	для екзамену, курсового проекту (роботи), практики, диф. заліку	для заліку	
90-100	відмінно	зараховано	A
82-89	добре		B
74-81			C
64-73	задовільно		D
60-63			E
35-59	незадовільно з можливістю повторного складання	не зараховано з можливістю повторного складання	Fx
0-34	незадовільно з обов’язковим повторним вивченням дисципліни	не зараховано з обов’язковим повторним вивченням дисципліни	F

13. Методичне забезпечення

1. Методичні вказівки для самостійної роботи і проведення практичних занять з дисципліни «Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків» (для

студентів освітньо – кваліфікаційного рівня «бакалавр» напрямів підготовки 6.030504 – Економіка підприємства і для слухачів другої вищої освіти освітньо – кваліфікаційного рівня «спеціаліст» спеціальностей 7.03050401 – Економіка підприємства) / В. Ф. Петрова; Харк. роф. Ун-т. міськ. Госп-ва. – Х.: ХНУМГ, 2013. – 65 с.

2. Методичні вказівки для виконання розрахунково-графічної роботи з дисципліни «Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків» (для студентів освітньо – кваліфікаційного рівня «бакалавр» напрямів підготовки 6.030504 – Економіка підприємства і для слухачів другої вищої освіти освітньо – кваліфікаційного рівня «спеціаліст» спеціальностей 7.03050401 – Економіка підприємства) / В. Ф. Петрова; Харк. роф. Ун-т. міськ. Госп-ва. – Х.: ХНУМГ, 2013. – 17 с.

3. Конспект лекцій з дисципліни «Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків» (для студентів освітньо - кваліфікаційного рівня «бакалавр» напрямів підготовки 6.030504 – Економіка підприємства і для слухачів другої вищої освіти освітньо - кваліфікаційного рівня «спеціаліст» спеціальностей 7.03050401 - Економіка підприємства) / В. Ф. Петрова; Харк. роф. Ун-т. міськ. Госп-ва. – Х.: ХНУМГ, 2014. – 74 с.

14. Рекомендована література

Базова

1. Вітлінський В.В., Верченко П.І. Аналіз, моделювання та управління економічним ризиком: Навч.-метод. посібник для самост. вивч. диск. –К.: КНЕУ, 2000.
2. Вітлінський В.В., Наконечний С.І. Ризик у менеджменті. –К.: ТОВ “Бори сфен – М”, 1996.
3. Гранатуров В.М. Экономический риск: сущность, методы измерения, пути снижения.: Уч. пособие. –М.: Дело и Сервис, 1999.
4. Клименко С.М., Дуброва О.С. Обґрунтування господарських рішень та оцінка ризиків: Навч. посібник. –К.: КНЕУ, 2005.
5. Клименко С.М., Дуброва О.С. Обґрунтування господарських рішень та оцінка ризиків: Навч.- метод. посіб. для самост. вивч. дисц. –К.: КНЕУ, 2006.
6. Смирнов Э. А. Разработка управленческих решений: Учеб. для вузов. — М.: ЮНИТИ-ДАНА, 2002.
7. Світлична Т.І. Теоретичні основи курсу “Економічний ризик та методи його вимірювання”. Навчальний посібник. Друге видання, доповнене і перероблене. Навч. . пос. –Харків: ХДАМГ, 2004.

Допоміжна

1. Абчук В.А. Предпринимательство и риск. – Л.: ЛФ ВИПК РП. 1991.
2. Глущенко В.В. Управление рисками. Страхование. –Железнодорожный: Крылья, 1999.
3. Дубров А.М., Лагаша Б.А., Хрусталеv Е.Ю. Моделирование рисковvх ситуаций в экономике и бизнесе: Уч. пос./ Под ред. Б.А.Лагоши. _ М.: Финансы и статистика, 1999.

4. Кігель В.Р. Методи і моделі підтримки прийняття рішень у ринковій економіці: Монографія. К.: ЦУЛ, 2003.
5. Колпаков В. М. Теория и практика принятия управленческих решений: Учеб. пособие. — К.: МАУП, 2000.
6. Первозванский А.А., Первозванская Т.Н. Финансовый рынок; расчет и риск.- М.: Инфа-М, 1994.
7. Томас Р. Количественный анализ хозяйственных операций и управленческих решений: Учебник. — М.: Дело и сервис, 2003.
8. Тони Райс, Брайн Койли. Финансовые инвестиции и риск. Пер. с англ.- К.: Торгово-издательское бюро ВНУ, 1995.
9. Шумпетер Й. Теория экономического развития (исследование предпринимательской прибыли, капитала, кредита, процента и цикла конъюнктуры).- М.: Прогресс, 1982.

15. Інформаційні ресурси

1. Цифровий репозиторій ХНУМГ [Електронний ресурс] – Режим доступу: <http://eprints.kname.edu.ua>.
2. Дистанційний курс «Обґрунтування господарських рішень і оцінювання ризиків» (для студентів освітньо-кваліфікаційного рівня «бакалавр» напрям підготовки 6.030504 – Економіка підприємства і слухачів другої вищої освіти спеціальності 7.03050401 – Економіка підприємства (за видами економічної діяльності) / Автор: Петрова В. Ф.

Аркуш актуалізації

Робоча програма навчальної дисципліни «ОБГРУНТУВАННЯ
ГОСПОДАРСЬКИХ РІШЕНЬ І ОЦІНЮВАННЯ РИЗИКІВ» за напрямом.
6.030504 – Економіка підприємства.

на 201.../1... навч. рік переглянута та затверджена "Без змін"

Завідувач кафедри _____
(на якій розроблена робоча програма)

_____ (_____)
(підпис) (прізвище та ініціали)

“ _____ ” _____ 201 _ року

Зав. випускової кафедри _____
(за належністю напрямку / спеціальності)

_____ (_____)
(підпис) (прізвище та ініціали)

“ _____ ” _____ 201 _ року

Декан факультету _____
(за належністю напрямку / спеціальності)

М.П.

_____ (_____)
(підпис) (прізвище та ініціали)

“ _____ ” _____ 201 _ року

на 201.../1... навч. рік переглянута та затверджена "Без змін"

Завідувач кафедри _____
(на якій розроблена робоча програма)

_____ (_____)
(підпис) (прізвище та ініціали)

“ _____ ” _____ 201 _ року

Зав. випускової кафедри _____
(за належністю напрямку / спеціальності)

_____ (_____)
(підпис) (прізвище та ініціали)

“ _____ ” _____ 201 _ року

Декан факультету _____
(за належністю напрямку / спеціальності)

М.П.

_____ (_____)
(підпис) (прізвище та ініціали)

“ _____ ” _____ 201 _ року

на 201.../1... навч. рік переглянута та затверджена "Без змін"

Завідувач кафедри _____
(на якій розроблена робоча програма)

_____ (_____)
(підпис) (прізвище та ініціали)

“ _____ ” _____ 201 _ року

Зав. випускової кафедри _____
(за належністю напрямку / спеціальності)

_____ (_____)
(підпис) (прізвище та ініціали)

“ _____ ” _____ 201 _ року

Декан факультету _____
(за належністю напрямку / спеціальності)

М.П.

_____ (_____)
(підпис) (прізвище та ініціали)

“ _____ ” _____ 201 _ року